

## Portfólió jelentés értékpapíralapra

### Alapadatok:

|                      |  |                                   |
|----------------------|--|-----------------------------------|
| Alap neve:           | CIB Vegyipar Tőkevédett Származtatott Részalap | Alap deviza: <b>MAGYAR FORINT</b> |
| ISIN kód:            | <b>HU0000730973</b>                            |                                   |
| Alapkezelő neve:     | <b>Eurizon Asset Management Hungary Zrt.</b>   |                                   |
| Letétkezelő neve:    | <b>CIB Bank Zrt.</b>                           |                                   |
| NEÉ számítás típusa: | T+1 napon számolt                              |                                   |
|                      | Tárgynap (T nap):                              | <b>2023.02.28</b>                 |
|                      | Saját tőke:                                    | 1 346 749 869                     |
|                      | Egy jegyre jutó NEÉ:                           | 1,07390000                        |
|                      | Darabszám:                                     | 1 254 116 409                     |
|                      | Tőkeáttétel mértéke bruttó:                    | 56,55 %                           |
|                      | Tőkeáttétel mértéke kötelezettség:             | 88,43 %                           |

### Eszközcsoportok

|  |               |
|--|---------------|
| I. Kötelezettségek                     | -8 099 919    |
| I/2. Egyéb kötelezettségek (összes)    | -8 099 919    |
| II. Eszközök                           | 1 354 849 788 |
| II/1. Folyószámla, készpénz (összes)   | 429 497 363   |
| II/2. Egyéb követelés (összes)         | 1 000 000     |
| II/3. Lekötött bankbetétek             | 535 614 925   |
| II/3.1. Max 3 hó lekötésű (összes)     | 535 614 925   |
| II/4. Értékpapírok                     | 232 867 500   |
| II/4.1. Állampapírok (összes)          | 232 867 500   |
| II/4.1.1. Kötvények (összes)           | 232 867 500   |
| II/5. Származékos ügyletek             | 155 870 000   |
| II/5.2. Opciók                         | 155 870 000   |
| II/5.2.2. OTC ill. OTC típusú (összes) | 155 870 000   |
| Eszközök összesen:                     | 1 354 849 788 |

### Devizakitevtség fedezettségi szintje tárgynapra

|     |        |
|-----|--------|
| HUF | 0,00 % |
|-----|--------|

### 10%-nál magasabb részarányt képviselő eszközök a portfólióban

|                   |         |
|-------------------|---------|
| Folyószámla (HUF) | 31,89 % |
| Betét összesen    | 39,77 % |
| MÁK 2025/C        | 17,29 % |
| GS_VEGYIPAR_opció | 11,57 % |